

Fecha de Publicación: 27 de abril de 2016

Fecha de Información: 25 de abril de lunes ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1494.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	280.8	331.0	203.6	141.4	12.4	24.5	115.0
15-35	542.3	305.9	201.0	220.0	11.9	229.3	93.0
36-60	2.4	39.4	0.0	0.0	39.4	2.4	0.0
61-90	4.0	27.2	0.0	0.0	27.2	4.0	0.0
91-180	105.4	60.2	0.0	40.0	60.2	65.4	0.0
>180	1.1	2.5	0.0	0.0	2.5	1.1	0.0
Total	935.9	766.2	404.6	401.4	153.6	326.6	208.0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.4 %	7.1 %	4.9 %	5.8 %
15-35	4.8 %	5.7 %	5.6 %	5.5 %
36-60	-	6.2 %	5.2 %	6.2 %
61-90	-	6.2 %	5.8 %	6.1 %
91-180	-	5.9 %	5.8 %	5.8 %
>180	-	6.5 %	5.4 %	6.2 %
Total	4.6 %	6.3 %	5.5 %	5.6 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	25 al 29 de abril				2 al 6 de mayo				9 al 13 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	96	176	3808	3501	381	168	3538	3539	10	114	2250	2180
Intragruppo y off-shore***	0	0	1749	1168	0	196	1863	1028	0	0	943	665
Otros	176	96	859	1747	168	185	530	1364	114	10	609	957
Total	272	272	6416	6416	548	548	5931	5931	124	124	3801	3801

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.